

# 诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2014 年半年度报告摘要

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	诺安中小板等权重 ETF 联接
基金主代码	320022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 10 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,723,400.49 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159921
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 10 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 31 日
基金管理人名称	诺安基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

注：目标基金的二级市场交易简称为“中小等权”，交易代码为“159921”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过将绝大部分基金财产投资于中小板等权重 ETF，密切跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为中小板等权重 ETF 的联接基金，主要通过投资于中小板等权重 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖中小板等权重 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。
业绩比较基准	中小板等权重指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为中小板等权重 ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，主要通过投资于中小板等权重 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中小板等权重指数及中小板等权重 ETF 的表现密切相关。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	目标基金投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
------	---

投资策略	目标基金采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	目标基金的业绩比较基准为中小板等权重指数收益率。
风险收益特征	目标基金是股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		诺安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	王涛
	联系电话	0755-83026688	95559
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-8998	95559
传真		0755-83026677	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,416,887.54
本期利润	33,371.93
加权平均基金份额本期利润	0.0033
本期基金份额净值增长率	0.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0972
期末基金资产净值	2,988,223.40
期末基金份额净值	1.097

注：① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

② 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③ 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

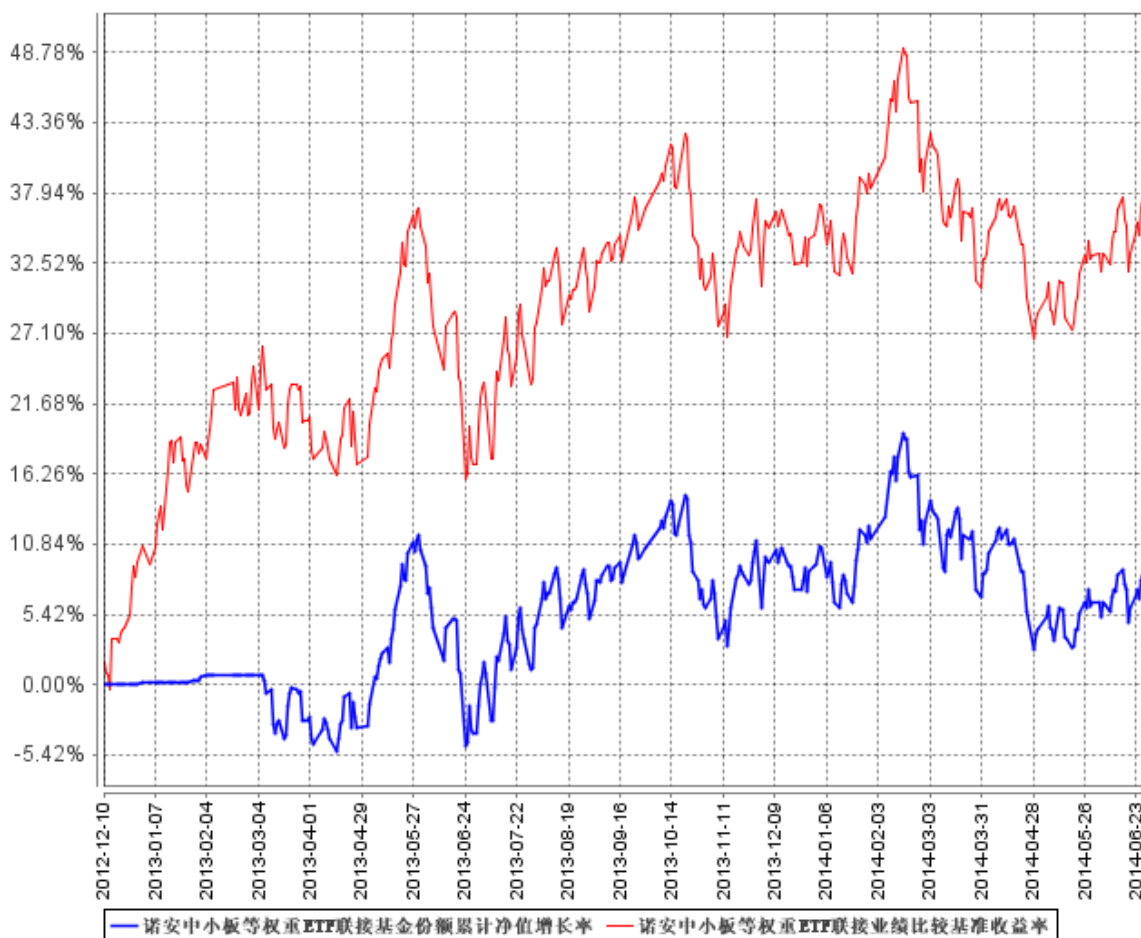
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.20%	0.97%	4.77%	1.07%	-1.57%	-0.10%
过去三个月	2.72%	1.03%	6.71%	1.07%	-3.99%	-0.04%
过去六个月	0.37%	1.22%	3.06%	1.26%	-2.69%	-0.04%
过去一年	13.91%	1.25%	19.09%	1.32%	-5.18%	-0.07%
自基金合同生效起至今	9.70%	1.20%	39.39%	1.40%	-29.69%	-0.20%

注：本基金的业绩比较基准为：中小板等权重指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

截至 2014 年 6 月，本基金管理人共管理 34 只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源

股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安理财宝货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋德舜	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。	2012 年 12 月 10 日	-	7	经济学博士，具有基金从业资格。曾任招商银行计划财务部资产负债管理经理，泰达荷银基金管理有限公司风险管理部副总经理。2010 年 4 月加入诺安基金管理有限公司，曾任诺安基金管理有限公司投资经理。2011 年 4 月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012 年 12 月起任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理和诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理人严格遵守了《中

《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情



况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内，本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整，原因是在较小的最小申赎单位下，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。本基金管理人在量化分析基础上，借助适当的组合优化模型，尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.097 元。本报告期基金份额净值增长率为 0.37%，同期业绩比较基准收益率为 3.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截止到报告期末，市场经历了一轮大的结构性行情，即以创业板为代表的小盘股表现好于以沪深 300 为代表的大盘股，事后的解释可以是基本面因素，也可以是技术因素，关键取决于投资者基于何种投资逻辑。任何走势预测都要基于不同的投资者心理才有意义，也就是说，投资者需要知道自己对风险和收益的承担范围，才可以借鉴外部关于行情的预测，做出符合自己特性的投资策略，否则，只能迷失在风险的大海中。展望未来一年，从技术角度，不要轻易看多大盘，也不应轻易看空小盘行情；从基本面角度，业绩的持续性确保了上市公司业绩大幅度变动的可能性很小，但是这并不意味着行情没有大的波动。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估

值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年最多分配 6 次,每次收益分配最低比例为 10%。

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014 年上半年度,基金托管人在诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 年上半年度,诺安基金管理有限公司在诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2014 年上半年度,由诺安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产:</b>		
银行存款	332,410.47	1,314,944.55
结算备付金	1,847.34	-
存出保证金	17,409.23	15,399.86
交易性金融资产	2,808,274.28	22,193,715.95
其中: 股票投资	2,808,274.28	1,439,715.95
基金投资	-	20,754,000.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	834.49	113,910.66
应收利息	145.66	669.18
应收股利	-	-
应收申购款	1,588.71	98.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,162,510.18	23,638,739.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,588.27	1,091.59
应付管理人报酬	1,200.47	1,145.69
应付托管费	240.11	229.14
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,650.59	8,412.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	168,607.34	120,004.11
负债合计	174,286.78	130,883.07
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	2,723,400.49	21,500,529.68
未分配利润	264,822.91	2,007,326.26
所有者权益合计	2,988,223.40	23,507,855.94

负债和所有者权益总计	3,162,510.18	23,638,739.01
------------	--------------	---------------

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.097 元，基金份额总额 2,723,400.49 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	267,949.55	249,129.06
1.利息收入	10,593.94	897,443.11
其中：存款利息收入	10,593.94	515,834.09
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	381,609.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,607,185.02	-316,378.02
其中：股票投资收益	151,980.54	-543,492.32
基金投资收益	1,435,674.36	225,350.98
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,530.12	1,763.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,383,515.61	-883,361.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	33,686.20	551,425.89
<b>减：二、费用</b>	234,577.62	640,835.55
1. 管理人报酬	7,098.76	264,066.00
2. 托管费	1,419.77	52,813.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	57,431.09	125,075.56
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	168,628.00	198,880.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	33,371.93	-391,706.49
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	33,371.93	-391,706.49

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,500,529.68	2,007,326.26	23,507,855.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,371.93	33,371.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-18,777,129.19	-1,775,875.28	-20,553,004.47
其中：1. 基金申购款	5,902,307.76	513,128.42	6,415,436.18
2. 基金赎回款	-24,679,436.95	-2,289,003.70	-26,968,440.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,723,400.49	264,822.91	2,988,223.40
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	409,477,879.95	618,556.83	410,096,436.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-391,706.49	-391,706.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-377,089,506.86	-1,432,251.60	-378,521,758.46
其中：1. 基金申购款	63,470,373.10	-852,335.42	62,618,037.68
2. 基金赎回款	-440,559,879.96	-579,916.18	-441,139,796.14
四、本期向基金份额持有	-	-	-



## 6.4.4.2 关联方报酬

### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,098.76	264,066.00
其中：支付销售机构的客户维护费	1,501.91	5,236.33

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,419.77	52,813.21

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基

金托管人。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	332,410.47	10,249.18	2,768,063.32	506,255.46

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.5 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002570	贝因美	2014年6	重大事项	14.36	-	-	2,635	39,195.36	37,838.60	-



		月 19 日								
002340	格林美	2014 年 6 月 26 日	重大事项	11.19	2014 年 7 月 25 日	11.30	2,654	28,263.68	29,698.26	-
002252	上海莱士	2014 年 6 月 13 日	重大资产重组	63.30	-	-	400	20,360.82	25,320.00	-
002151	北斗星通	2014 年 5 月 19 日	重大事项	24.80	2014 年 8 月 15 日	27.28	1,000	27,985.10	24,800.00	-
002167	东方锆业	2014 年 1 月 2 日	重大资产重组	11.39	2014 年 7 月 1 日	11.10	1,400	15,067.87	15,946.00	-

### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

### 6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (3) 以公允价值计量的金融工具

##### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

##### ② 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,674,671.42 元，属于第二层级的余额为 133,602.86 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 22,143,546.95 元，第二层级的余额为 50,169.00 元，无属于第三层级的余额)。

##### ③ 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行

等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,808,274.28	88.80
	其中：股票	2,808,274.28	88.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	334,257.81	10.57
8	其他各项资产	19,978.09	0.63
9	合计	3,162,510.18	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	88,088.70	2.95
B	采矿业	29,261.76	0.98
C	制造业	1,964,794.22	65.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	144,317.96	4.83
F	批发和零售业	145,732.84	4.88

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,261.18	4.89
J	金融业	86,732.22	2.90
K	房地产业	57,781.68	1.93
L	租赁和商务服务业	115,488.04	3.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,815.68	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,808,274.28	93.98

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002570	贝因美	2,635	37,838.60	1.27
2	002190	成飞集成	559	32,981.00	1.10
3	002475	立讯精密	1,000	32,780.00	1.10
4	002052	同洲电子	3,591	32,283.09	1.08
5	002104	恒宝股份	1,617	31,693.20	1.06
6	002292	奥飞动漫	848	31,121.60	1.04
7	002353	杰瑞股份	770	30,992.50	1.04
8	002023	海特高新	1,617	30,884.70	1.03
9	002049	同方国芯	1,300	30,875.00	1.03
10	002129	中环股份	1,616	30,817.12	1.03

提示：投资者欲了解本报告期末投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002219	恒康医疗	93,902.00	0.40
2	002415	海康威视	92,357.00	0.39
3	002304	洋河股份	87,617.20	0.37
4	002183	怡亚通	87,464.00	0.37
5	002594	比亚迪	86,701.00	0.37
6	002269	美邦服饰	85,505.00	0.36
7	002024	苏宁云商	85,122.00	0.36
8	002079	苏州固锝	82,207.00	0.35
9	002242	九阳股份	76,954.00	0.33
10	002250	联化科技	76,597.00	0.33
11	002161	远望谷	76,584.00	0.33
12	002570	贝因美	75,283.00	0.32
13	002052	同洲电子	73,456.00	0.31
14	002236	大华股份	73,336.00	0.31
15	002028	思源电气	72,800.00	0.31
16	002385	大北农	72,001.49	0.31
17	002007	华兰生物	71,679.00	0.30
18	002048	宁波华翔	71,596.00	0.30
19	002056	横店东磁	71,501.00	0.30
20	002399	海普瑞	70,789.84	0.30

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002304	洋河股份	363,671.92	1.55
2	002594	比亚迪	358,695.24	1.53
3	002219	恒康医疗	354,227.30	1.51
4	002048	宁波华翔	340,979.32	1.45
5	002123	荣信股份	334,259.77	1.42
6	002183	怡亚通	333,150.16	1.42
7	002056	横店东磁	328,393.28	1.40
8	002079	苏州固锝	327,496.24	1.39
9	002091	江苏国泰	321,411.20	1.37

10	002202	金风科技	315,501.50	1.34
11	002022	科华生物	312,285.92	1.33
12	002073	软控股份	309,691.65	1.32
13	002191	劲嘉股份	304,186.05	1.29
14	002008	大族激光	302,977.79	1.29
15	002065	东华软件	302,164.91	1.29
16	002093	国脉科技	301,527.38	1.28
17	002237	恒邦股份	300,170.40	1.28
18	002275	桂林三金	299,336.44	1.27
19	002028	思源电气	299,151.46	1.27
20	002153	石基信息	298,615.76	1.27

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,535,765.40
卖出股票收入（成交）总额	24,795,433.02

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,409.23
2	应收证券清算款	834.49
3	应收股利	-
4	应收利息	145.66
5	应收申购款	1,588.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,978.09

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002570	贝因美	37,838.60	1.27	重大事项

**7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
203	13,415.77	4,951.30	0.18%	2,718,449.19	99.82%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	352,012.30	12.9255%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 12 月 10 日) 基金份额总额	409,477,879.95
本报告期期初基金份额总额	21,500,529.68

本报告期基金总申购份额	5,902,307.76
减:本报告期基金总赎回份额	24,679,436.95
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,723,400.49

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会,没有基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金的投资组合策略没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	



民族证券	1	31,330,096.82	100.00%	28,522.73	100.00%	-
------	---	---------------	---------	-----------	---------	---

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1)、实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2)、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3)、经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4)、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5)、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需, 并能为本基金提供全面的信息服务。
- (6)、研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期租用证券公司交易单元没有进行其他证券投资。

投资者对本报告书如有疑问, 可致电本基金管理人全国统一客户服务电话: 400-888-8998, 亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2014年8月26日